INSTRUCTIVO 2012 B

CARGA AUTOMATICA DE PROPUESTAS

1. Introducción

Con el fin de proporcionar un mecanismo que permita vincular los sistemas de registro y administración de órdenes con el ingreso de propuestas al mercado, sea dispuesta la incorporación de un mecanismo de carga automática de propuestas desde el terminal de negociación.

A diferencia de la funcionalidad denominada “propuestas batch” (descrita en el anexo 04C del manual de usuario ELEX) el mecanismo descrito en este documento permite el ingreso de propuestas sin el uso del formulario de ingreso del terminal de negociación.

2. Descripción General

- La funcionalidad de carga automática de órdenes estará habilitada únicamente para usuarios con perfil Operador (perfil "A").
- Los usuarios Elex con perfiles de Consulta ("C") y Lectura ("L") no podrán activar esta funcionalidad.
- Los archivos con la extensión adecuada (“.aut”) serán procesados automáticamente durante las horas hábiles de negociación conforme aparezcan en el directorio pre-definido para tal efecto.
- Si hay archivos presentes en el directorio designado, generados previamente al ingreso del Usuario correspondiente en su cuenta ELEX, tales archivos serán leídos y cargados en el momento en que el usuario acceda al sistema (suponiendo que ingresa en un horario hábil para la negociación).
- La ruta correspondiente al folder desde el cual han de ser cargados los archivos será establecida mediante una configuración en el registro de Windows.
- Dicha ruta podrá corresponder a un disco local en la PC del usuario o bien a un directorio compartido de red.
- El número máximo de registros de propuestas que será leído en cada archivo con extensión “.aut” es 50 registros. Sin embargo, será posible mantener y cargar consecutivamente más de un archivo con propuestas. Para tal efecto, los archivos a ser procesados deben tener nombres diferentes entre sí.
- Con el fin de evitar el proceso duplicado de un mismo archivo, el terminal de negociación modificará la extensión de los archivos ya procesados. La extensión asignada a tales archivos será ".old"
- En caso de presentarse errores en el ingreso de órdenes registradas en los archivos .aut, la ventana de información del terminal de negociación mostrará los mensajes correspondientes.
- El formato de los archivos a ser cargados en forma automática será similar al formato de los archivos usados para la carga de las denominadas "propuestas batch" (descritas en el Anexo 04C del Manual de usuario ELEX).
- No obstante lo indicado, con el fin de permitir la cancelación y modificación de propuestas, el formato de los nuevos archivos “.aut” incorpora dos campos adicionales:

- Número de propuesta (*)
- Fecha hora de ingreso (*)

(*) Datos asignados por el sistema ELEX a una propuesta previamente ingresada.

- Las reglas aplicables al ingreso, modificación y cancelación de propuestas contenidas en los archivos serán las mismas que aplican para la ejecución de tales acciones mediante los formularios del terminal de negociación.

Supuestos Técnicos:

- Esta funcionalidad se apoya en la premisa de que la generación de archivos ".aut" se ejecutará tomando las medidas necesarias para evitar la carga de archivos incompletos, o parcialmente transferidos al folder pre-definido para la lectura y carga de los mismos
- En caso de uso de un directorio compartido de red: la ausencia de comportamiento no deseado asociado a tiempo de espera bajo entorno Windows (“Windows timeout”), se basa en la premisa de que el acceso a dicho recurso de red es eficiente y confiable.

3. Selección del Directorio de Carga

3.1 Configuración del Registro de Windows

A continuación se detalla los pasos para configurar el registro que especifica una ruta de acceso a un directorio ubicado en la PC del usuario.

Nota: Siendo la configuración del registro en Windows una acción con la cual no todos los usuarios están familiarizados, la ejecución de esta actividad puede requerir el apoyo del personal de soporte técnico de la agencia.

El primer paso consiste en debe crear un registro denominado **AutomaticOrderFolder** en la siguiente ruta **Equipo\HKEY_CURRENT_USER\software\xTradesoft\ELEX\Settings**

Donde “Equipo” representa el nombre asignado a la PC del usuario.

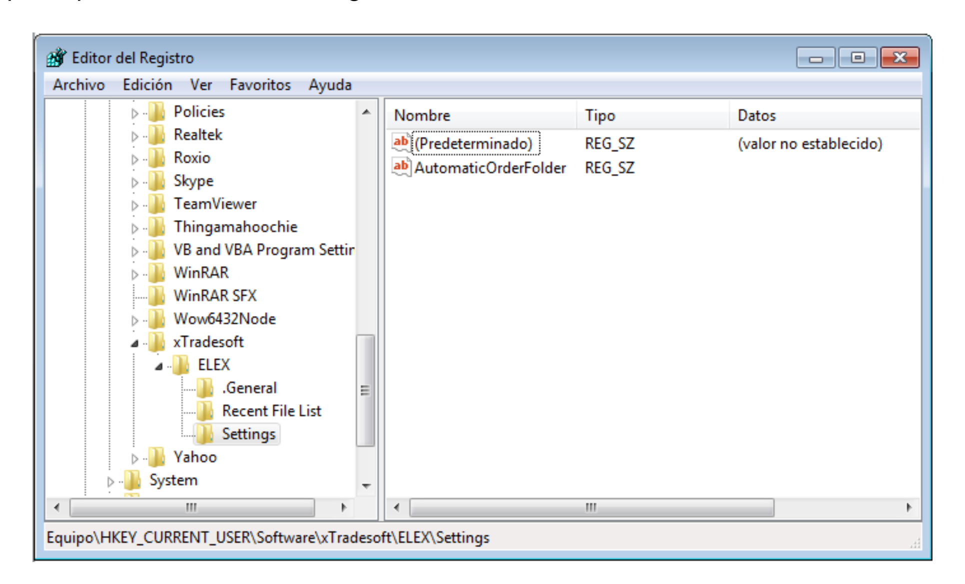


Figura 1

El siguiente paso ha de ser el ingreso de contenido en el registro creado. El contenido a ser ingresado es la ruta del directorio (carpeta) donde se desea ubicar los archivos que han de ser leídos y cargados al

La ruta ingresada debe presentar el carácter “ \ “ al final de la misma.

Ejemplo:

Si se desea que los archivos .aut que contienen las propuestas a ser ingresadas estén ubicados en “**C:\workspace**”, entonces el contenido del registro debe ser “**C:\workspace**”.

Para agregar contenido al registro se debe ingresar la ruta en el formulario “editar cadena” que se muestra en la figura 2

Nota: El ingreso del contenido (ruta) en el registro es opcional:

- Si se ingresa una ruta en el registro de Windows, el sistema tomará en cuenta la ruta ingresada.

- Si no se ingresa una ruta en el registro, el sistema tomará en cuenta la carpeta de trabajo donde se encuentra el ejecutable del terminal ELEX.

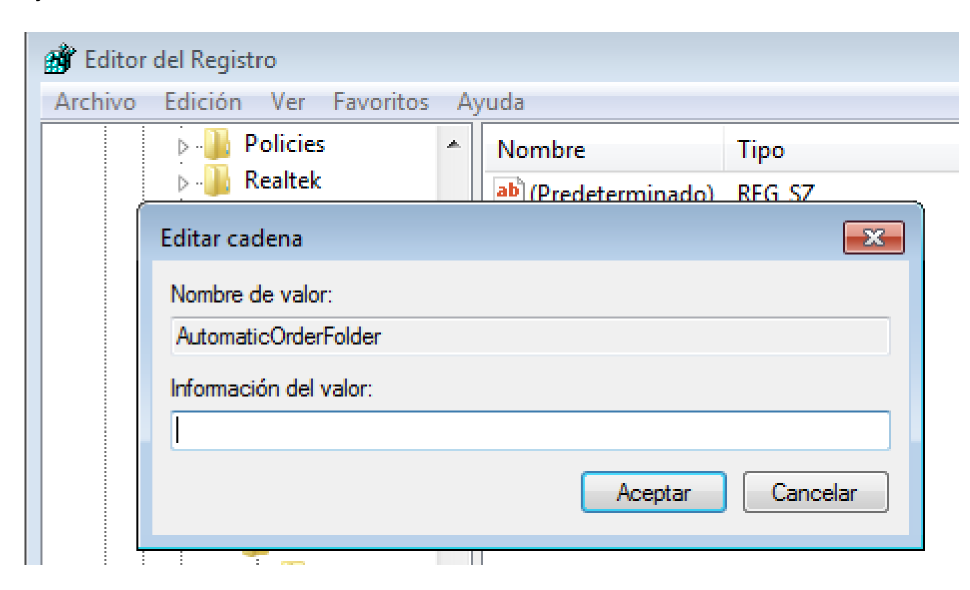


Figura 2

4.- Archivos de Carga Automática

4.1 Descripción del Formato.

El archivo deberá de tener extensión **.aut** y el formato para el ingreso de propuestas es el siguiente:

Mercado|Tipo|Valor|Precio|Duración|Cantidad|Referencia|FPT FECHA|Corto|Num Orden|Fecha/Hora

Debiéndose considerar lo siguiente en cada uno de los campos:

- **Mercado –** El contenido en este campo deberá ser siempre “0”.
- **Tipo** – El contenido es “B” para propuestas de compra y “S” para propuestas de venta
- **Valor** – código mnemónico del valor en letras mayúsculas..
- **Precio** – precio de la propuesta considerando dos dígitos decimales. En este campo no se debe registrar el punto decimal.
- **Duración** – Condición de Vigencia de la Propuesta:

"D", para propuestas HOY / DAY

"G", (para propuestas PERM / GTC

"T", para propuestas FPT / GTD

"F", para propuestas TON / FOK

"I", para propuestas IOC/ F&K

Nota: Cuando el archivo contenga el registro de una propuesta previamente ingresada, destinado a cancelar dicha propuesta, la omisión de este campo será el mecanismo para expresar el comando de cancelación.

- **Cantidad** – Cantidad de valores, expresada en unidades.
- **Referencia** – campo opcional de texto libre (máximo10 caracteres) para el ingreso de información referencial.
- **FPT Fecha** – corresponde a la fecha de vencimiento de la propuesta con duración FTP expresada en formato YYYY/MM/DD.
- **Corto**– indica si el registro de la propuesta corresponde a una venta descubierta: 1 = SI / 0 = NO
- **Num Order-** Corresponde al número asignado por el sistema Elex a una propuesta previamente ingresada). Este campo tiene la finalidad de identificar la propuesta para propósitos de modificación o cancelación de la misma.
- **Fecha/Hora-** Corresponde al número asignado por el sistema Elex a una propuesta previamente ingresada). Este campo tiene la finalidad de identificar la propuesta para propósitos de modificación o cancelación de la misma. El formato correspondiente a este campo es el siguiente: YYYY/MM/DD hh:mm:ss.

4.2 Ejemplos

Ejemplo 1
Ingresa propuesta de Compra del instrumento **XYZW**
Cantidad: 17,502
Precio: S/. 8.56
Vigencia: Hoy
Referencia: "ABC"

0|B|XYZW|856|D|17502|ABC||0||

Ejemplo 2
Ingresa propuesta de Venta del instrumento **XYZW**
Cantidad: 30,425
Precio: S/. 8.91
Vigencia: FTP
Vencimiento: 15/Abr/2013
Referencia: "EFG"

0|S|XYZW|891|T|30425|EFG|2013/04/15|0||

Ejemplo 3
Cancela la propuesta ingresada en el ejemplo 1
Supuesto: La propuesta ingresada en el ejemplo 1 ha sido aceptada previamente en el sistema ELEX y esta identificada mediante la siguiente información
Numero: 628.
Fecha/Hora: 27/12/2012 13:25:02

0|B|XYZW|856||17502|ABC||0|628|27/12/2012 13:25:02

Ejemplo 4
Modifica la propuesta ingresada en el ejemplo 2 (reduce cantidad a 20,725)
Supuesto: La propuesta ingresada en el ejemplo 2 ha sido aceptada previamente en el sistema ELEX y esta identificada mediante la siguiente información
Numero: 392.
Fecha/Hora: 28/12/2012 14:35:01

0|S|XYZW|891|T|20725|EFG|2013/04/15|0|392|28/12/2012 14:35:01